

广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）

2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6	审计报告	12
6.1	管理层对财务报表的责任.....	12
6.2	注册会计师的责任	13
6.3	审计意见	13
§ 7	年度财务报表	13
7.1	资产负债表	13
7.2	利润表	15
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4	报表附注	17
§ 8	投资组合报告	38
8.1	期末基金资产组合情况.....	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	38
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	53
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	53
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	53

8.9	投资组合报告附注	53
§ 9	基金份额持有人信息	54
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	54
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	55
§ 10	开放式基金份额变动	55
§ 11	重大事件揭示	55
11.1	基金份额持有人大会决议.....	55
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
11.4	基金投资策略的改变	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8	其他重大事件	61
§ 12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	广发中证 500 指数 (LOF)
场内基金简称	广发 500
基金主代码	162711
交易代码	162711
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 26 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,885,836,712.17 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 1 月 8 日

2.2 基金产品说明

投资目标	采用被动式投资策略, 通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段, 力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%, 实现对中证 500 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时, 基金管理人会对投资组合进行适当调整, 降低跟踪误差。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×银行同业存款收益率。
风险收益特征	较高风险、较高预期收益, 风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	段西军	赵会军

负责人	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市拱北情侣南路255号4层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		王志伟	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所有限公司	上海市延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年	2010 年	2009 年 11 月 26 日(基金合同生效日) 至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	44,944,995.38	426,851,422.10	-8,066,400.18
本期利润	-1,345,823,312.87	718,925,432.10	79,022,264.89
加权平均基金份额本期利润	-0.3658	0.1301	0.0092
本期加权平均净值利润率	-36.86%	12.93%	0.92%
本期基金份额净值增长率	-32.51%	8.52%	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-1,013,820,922.67	315,943,209.20	-8,066,400.18
期末可供分配基金份额利	-0.2609	0.0924	-0.0009

润			
期末基金资产净值	2,872,015,789.50	3,743,533,954.54	8,714,819,488.87
期末基金份额净值	0.739	1.095	1.009
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	-26.10%	9.50%	0.90%

注：1.本基金合同于 2010 年 4 月 19 日生效。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.57%	1.59%	-14.52%	1.62%	-0.05%	-0.03%
过去六个月	-27.26%	1.49%	-27.21%	1.52%	-0.05%	-0.03%
过去一年	-32.51%	1.42%	-32.10%	1.45%	-0.41%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-26.10%	1.54%	-26.14%	1.61%	0.04%	-0.07%

注：业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

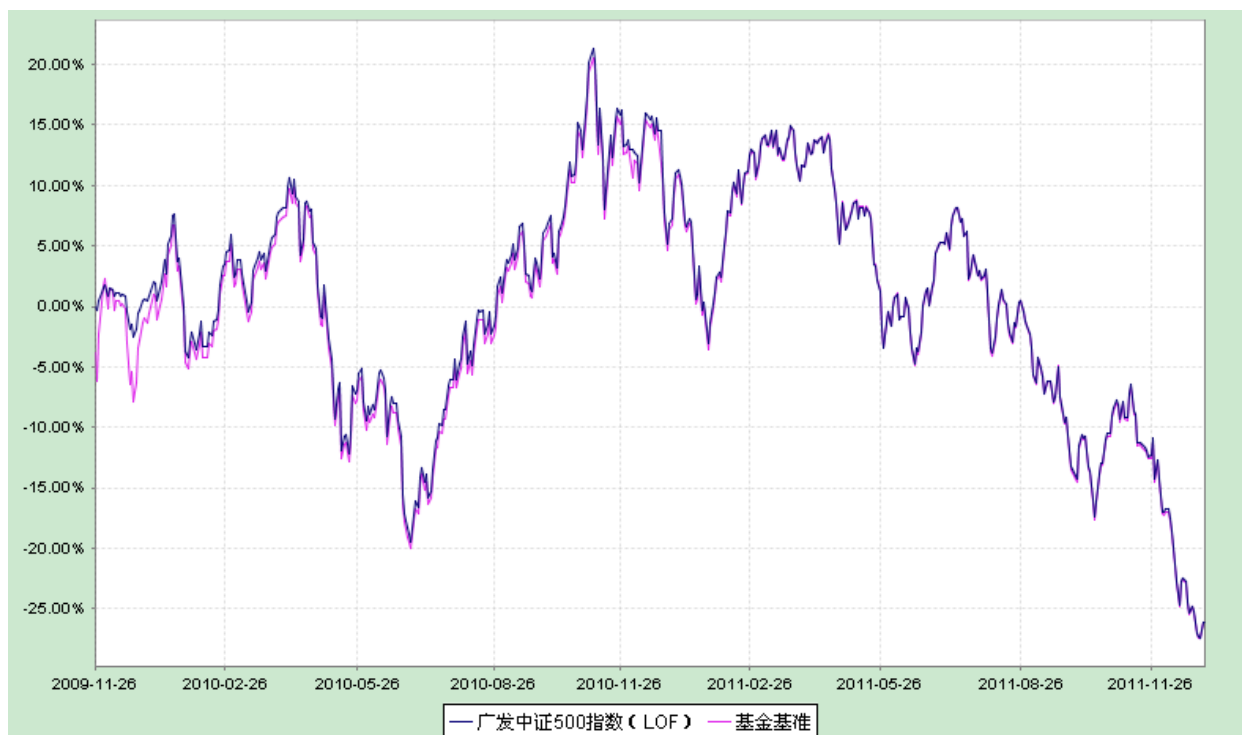
业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

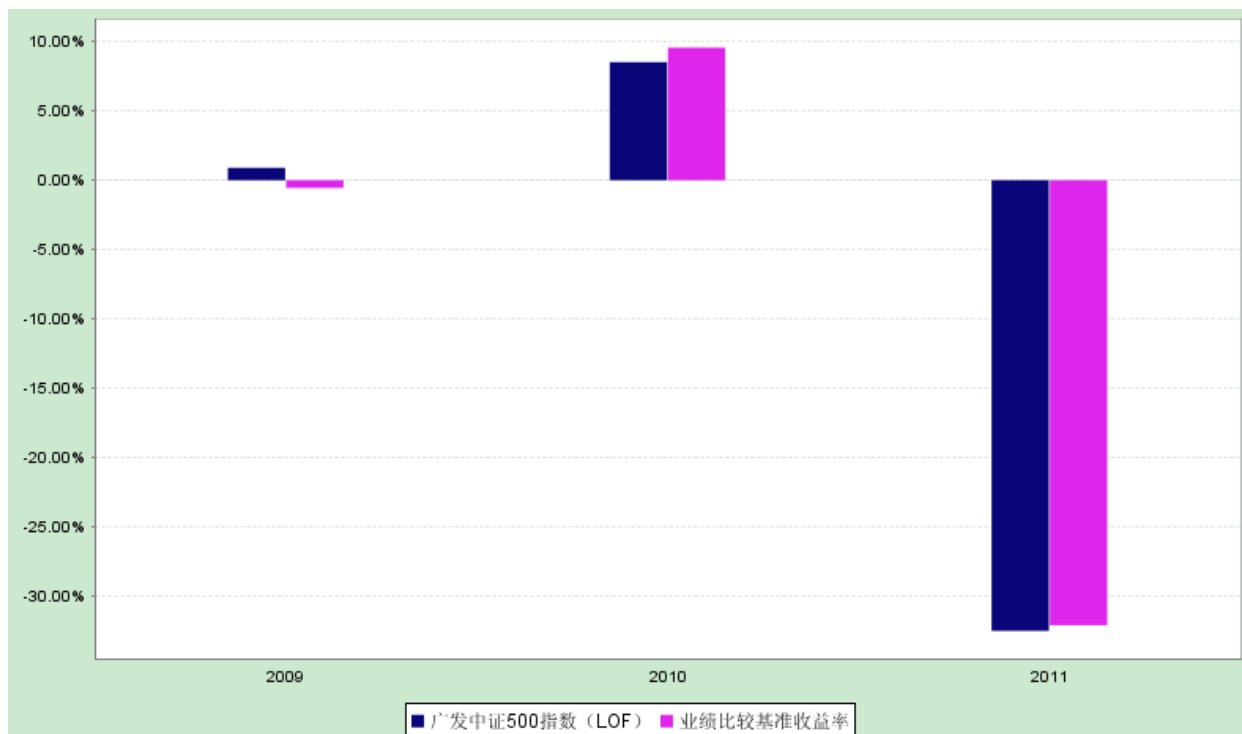
(2009 年 11 月 26 日至 2011 年 12 月 31 日)



3.2.3 合同生效日以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：合同生效当年（2009 年）按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2009 年 11 月 26 日）至报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。公司具有企业年金投资管理人、QDII、特定资产管理业务资格和社保基金投资管理人资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 17 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、机构理财部、市场拓展部、国际业务部。此外，还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金管理人管理二十一只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金 (LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发亚太（除日本）精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金和广发制造业精选股票型证券投资基金，管理资产规模为 983.80 亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金、特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈盛业	本基金的基金经理； 广发沪深 300 指数基金的基金经理	2010-12-01	-	4	男，中国籍，经济学博士，持有证券业执业证书，2007 年 3 月至 2009 年 9 月任广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组主管，2009 年 9 月至 2010 年 8 月任广发基金管理有限公司机构投资部投资经理，2010 年 8 月至今在广发基金管理有限公司数量投资部工作，2010 年 12 月 1 日起任广发沪深 300 指数基金及广发中证 500 指数 (lof) 基金的基金经理。

注：(1) 基金经理的“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，

确保交易的公平。

监察稽核部风险控制管理岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警, 实现投资风险的事中风险控制; 监察稽核部稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核, 实现投资风险的事后控制。

本报告期内, 上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人未管理与本投资组合投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金管理人在投资管理活动中公平对待不同投资组合, 未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1) 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内, 本基金日均跟踪误差为 0.06%, 年化跟踪误差为 0.91%, 符合基金合同中规定的日均跟踪误差不超过 0.35% 和年跟踪误差不超过 4% 的要求。

报告期内, 本基金跟踪误差来源主要有两个: 一是基金成份股调整因素, 本基金结合标的指数成分股调整面积较大的实际情况, 分批对成份股进行调整, 较好的控制了成份股调整的冲击成本; 二是申购和赎回因素, 本基金规模较大, 申购赎回因素对本基金跟踪误差的影响较小。

(2) 简要展望

作为指数基金, 本基金将继续秉承指数化被动投资策略, 积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击, 进一步降低基金的跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-32.51%, 业绩比较基准收益率为-32.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从去年四季度以后, 国内的流动性有好转的迹象, 市场参与者的风险偏好也在上升。在这个环境下, 以中证 500 为代表的中小盘股估值恢复得较好, 交易的活跃度也明显改善。展望 2012 年, 流动性

应该不会再比去年四季度更紧张，经济也将逐步筑底。以此推测，中证 500 指数的表现将会明显改观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“(三)基金收益分配原则”的相关规定，本基金截至 2011 年 12 月 31 日可供分配利润为 -1,013,820,922.67 元，未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2011 年, 本基金托管人在对广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年, 广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的管理人——广发基金管理有限公司在广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 2011 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

德师报(审)字(12)第 P0211 号

广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)全体持有人:

我们审计了后附的广发中证 500 指数证券投资基金(LOF) (以下简称“广发中证 500 指数(LOF)”) 的财务报表, 包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表, 2011 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发中证 500 指数(LOF)的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任, 这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作

的有关规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，广发中证 500 指数(LOF)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了广发中证 500 指数(LOF)2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

德勤华永会计师事务所有限公司 注册会计师 胡小骏 余志亮

上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

2012-03-27

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	178,465,857.09	191,278,749.35
结算备付金		7,693,630.53	1,744,639.64
存出保证金		1,381,355.05	2,134,043.94
交易性金融资产	7.4.7.2	2,715,335,617.35	3,553,483,384.27
其中：股票投资		2,715,335,617.35	3,552,915,245.23
基金投资		-	-
债券投资		-	568,139.04
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	38,391.66	41,810.99
应收股利		-	-
应收申购款		1,388,836.06	31,761,980.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,904,303,687.74	3,780,444,608.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		27,961,619.88	28,677,157.22
应付赎回款		1,591,348.62	3,581,016.25
应付管理人报酬		1,582,257.81	1,961,194.29
应付托管费		395,564.46	490,298.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	473,696.33	2,109,408.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	283,411.14	91,578.94
负债合计		32,287,898.24	36,910,654.13
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,885,836,712.17	3,418,670,771.06
未分配利润	7.4.7.10	-1,013,820,922.67	324,863,183.48
所有者权益合计		2,872,015,789.50	3,743,533,954.54
负债和所有者权益总计		2,904,303,687.74	3,780,444,608.67

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.739 元，基金份额总额 3,885,836,712.17 份。

7.2 利润表

会计主体：广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入		-1,310,972,840.12	783,017,609.41
1. 利息收入		2,446,994.81	3,159,319.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,400,853.83	3,157,943.22
债券利息收入		3,130.09	1,376.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,043,010.89	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		74,505,818.96	473,422,346.09
其中：股票投资收益	7.4.7.12	55,706,962.45	451,115,839.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	329,524.39	229,778.26
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	18,469,332.12	22,076,728.63
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-1,390,768,308.25	292,074,010.00
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.17	2,842,654.36	14,361,933.50

列)			
减：二、费用		34,850,472.75	64,092,177.31
1. 管理人报酬		21,887,374.90	33,586,022.48
2. 托管费		5,471,843.62	8,396,505.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,035,059.91	21,605,282.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	456,194.32	504,367.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-1,345,823,312.87	718,925,432.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-1,345,823,312.87	718,925,432.10

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,418,670,771.06	324,863,183.48	3,743,533,954.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,345,823,312.87	-1,345,823,312.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	467,165,941.11	7,139,206.72	474,305,147.83
其中：1. 基金申购款	2,911,914,193.26	57,694,981.49	2,969,609,174.75
2. 基金赎回款	-2,444,748,252.15	-50,555,774.77	-2,495,304,026.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,885,836,712.17	-1,013,820,922.67	2,872,015,789.50
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,635,797,223.98	79,022,264.89	8,714,819,488.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	718,925,432.10	718,925,432.10
三、本期基金份额交易产生的基金净	-5,217,126,452.92	-473,084,513.51	-5,690,210,966.43

值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	5,726,032,038.80	123,676,102.73	5,849,708,141.53
2. 基金赎回款	-10,943,158,491.72	-596,760,616.24	-11,539,919,107.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,418,670,771.06	324,863,183.48	3,743,533,954.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人: 王志伟, 主管会计工作负责人: 林传辉, 会计机构负责人: 张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发中证 500 指数证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2009]982 号文核准, 由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发中证 500 指数证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起, 于 2009 年 11 月 26 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金已向证监会备案, 并于 2009 年 11 月 26 日获得确认。

本基金募集期为 2009 年 10 月 22 日至 2009 年 11 月 20 日, 本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定, 首次募集资金为人民币 8,635,797,223.98 元, 有效认购户数为 107,956 户。其中, 认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 634,322.52 元, 折合基金份额 634,322.52 份, 按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。基金合同于 2009 年 11 月 26 日生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 8,635,797,223.98 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定, 本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括中证 500 指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、到期日在一年以内的政府债券及法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准采用: $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款收益率}$ 。

本基金的财务报表于 2012 年 3 月 27 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、基金合同、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

(1)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

-股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

-债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

-权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(2)贷款及应收款项

-买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

(3)其他金融负债

-卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2)对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3)当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上或基金管理人估值委员会认为必要时，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

具体投资品种的估值方法如下：

股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易

所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含债券应收利息后的净价为公允价值。未上市流通的债券按成本估值。

全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别确定公允价值。

权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为：

第 1 层级：同类资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第 2 层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值；

第 3 层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

投资收益

股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.60%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次分配比例不低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外投资者可选择现金分红或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内投资者的收益分配方式为现金分红，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后，不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- 1、以发行基金方式募集资金, 不属于营业税征收范围, 不缴纳营业税。
- 2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。
- 3、对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 上市公司在代扣代缴时, 减按 50% 计算应纳税所得额。
- 4、对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。
- 5、对于基金从事 A 股买卖, 自 2008 年 9 月 19 日起, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。
- 6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价, 暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	178,465,857.09	191,278,749.35
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	178,465,857.09	191,278,749.35

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,726,941,250.53	2,715,335,617.35	-1,011,605,633.18

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,726,941,250.53	2,715,335,617.35	-1,011,605,633.18
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		3,173,943,909.20	3,552,915,245.23	378,971,336.03
债券	交易所市场	376,800.00	568,139.04	191,339.04
	银行间市场	-	-	-
	合计	376,800.00	568,139.04	191,339.04
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,174,320,709.20	3,553,483,384.27	379,162,675.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	34,929.56	40,354.71
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,462.10	610.60
应收债券利息	-	845.68
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	38,391.66	41,810.99

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	473,696.33	2,109,408.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	473,696.33	2,109,408.86

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,411.14	11,578.94
预提费用	280,000.00	80,000.00
合计	283,411.14	91,578.94

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,418,670,771.06	3,418,670,771.06
本期申购	2,911,914,193.26	2,911,914,193.26
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,444,748,252.15	-2,444,748,252.15
本期末	3,885,836,712.17	3,885,836,712.17

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	315,943,209.20	8,919,974.28	324,863,183.48
本期利润	44,944,995.38	-1,390,768,308.25	-1,345,823,312.87
本期基金份额交易产生的变动数	48,053,967.43	-40,914,760.71	7,139,206.72
其中：基金申购款	320,310,603.19	-262,615,621.70	57,694,981.49
基金赎回款	-272,256,635.76	221,700,860.99	-50,555,774.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	408,942,172.01	-1,422,763,094.68	-1,013,820,922.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31
----	----------------------------	---------------------------------

	日	日
活期存款利息收入	1,239,491.13	2,941,296.60
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	87,276.98	89,362.67
其他	74,085.72	127,283.95
合计	1,400,853.83	3,157,943.22

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	2,218,362,314.35	8,285,234,093.92
减：卖出股票成本总额	2,162,655,351.90	7,834,118,254.72
买卖股票差价收入	55,706,962.45	451,115,839.20

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	2,837,500.16	2,009,109.18
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	2,504,000.00	1,778,800.00
减：应收利息总额	3,975.77	530.92
债券投资收益	329,524.39	229,778.26

7.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	18,469,332.12	22,076,728.63
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	18,469,332.12	22,076,728.63

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,390,768,308.25	292,074,010.00
——股票投资	-1,390,576,969.21	291,882,670.96
——债券投资	-191,339.04	191,339.04
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,390,768,308.25	292,074,010.00

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	2,839,066.18	14,361,432.14
基金转换费收入	3,588.18	501.36
合计	2,842,654.36	14,361,933.50

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	7,035,059.91	21,605,282.14
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,035,059.91	21,605,282.14

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	16,194.32	34,367.15
上市费	60,000.00	90,000.00
其他	-	-
合计	456,194.32	504,367.15

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日, 本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
华福证券有限责任公司(原名: 广发华福证券有限责任公司)	基金管理人股东的原子公司(2010 年 12 月 28 日之前)、代销机构(注 1)
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
香江投资有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)	基金管理人全资子公司(注 2)

注: 1: 广发证券股份有限公司于 2010 年 12 月 28 日将其持有广发华福证券有限责任公司的股权全部转让。广发华福证券有限责任公司在本报告期末及上年度末与本基金不属于关联方。广发华福证券有限责任公司于 2011 年 7 月 22 日更名为“华福证券有限责任公司”。

2: 广发基金管理有限公司于 2010 年 12 月 10 日在香港设立全资子公司广发国际资产管理有限公司(GF International Investment Management Limited)。

除此之外, 本报告期内及上年度可比期间内不存在其他控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
广发证券股份有限公司	494,904,892.34	10.07%	1,662,390,806.87	12.06%
华福证券有限责任公司	-	-	68,353,631.42	0.50%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	764,451.00	26.94%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	488,000,000.00	5.82%	-	-

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限	420,670.58	10.86%	46,107.51	9.73%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限	1,368,161.85	12.65%	-	-
华福证券有限责任	56,982.07	0.53%	-	-

注：1：股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)。

2：本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

3：本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,887,374.90	33,586,022.48
其中：支付销售机构的客户维护费	4,418,540.31	8,311,990.15

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,471,843.62	8,396,505.54

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首二个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联交易对手进行银行间同业市场的债券(含回购)交

易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	100,006,000.06	100,006,000.06
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	100,006,000.06	100,006,000.06
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.57%	2.93%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	178,465,857.09	1,239,491.13	191,278,749.35	2,941,296.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	------	-------	--------	--------	----

				价		单价					
600056	中国医药	2011-11-16	重大事项	20.24		-	-	236,263	4,819,415.26	4,781,963.12	-
600121	郑州煤电	2011-10-10	重大事项	10.43	2012-01-13	11.47		556,101	6,592,428.61	5,800,133.43	-
600332	广州药业	2011-11-07	重大事项	13.14		-	-	445,169	6,165,255.14	5,849,520.66	-
600820	隧道股份	2011-12-27	重大事项	7.87	2012-01-04	8.15		982,948	10,932,956.48	7,735,800.76	-
600963	岳阳林纸	2011-12-27	重大事项	4.68	2012-01-04	4.92		1,291,345	11,592,777.21	6,043,494.60	-
600991	广汽长丰	2011-12-28	重大事项	14.72	2012-01-04	15.11		398,856	4,724,056.31	5,871,160.32	-
000005	世纪星源	2011-05-03	重大事项	3.86		-	-	1,299,171	7,015,406.43	5,014,800.06	-
000522	白云山 A	2011-11-07	重大事项	12.16		-	-	618,290	9,013,317.24	7,518,406.40	-
000655	金岭矿业	2011-12-12	重大事项	14.80	2012-02-07	16.28		582,931	12,835,539.39	8,627,378.80	-
000677	ST 海龙	2011-08-22	重大事项	4.82		-	-	924,948	6,846,844.32	4,458,249.36	-
000816	江淮动力	2011-11-07	重大事项	7.04	2012-02-27	6.51		1,640,391	9,869,015.59	11,548,352.64	-
002051	中工国际	2011-12-08	重大事项	25.18	2012-03-19	30.00		347,867	7,548,254.01	8,759,291.06	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止, 本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止, 本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款, 无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

本基金本报告期末未持有债券投资。本基金上年度末持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券仅占基金资产净值的 0.01%，因此与债券相关的信用风险不重大。

7.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

7.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响,导致基金收益水平变化而产生的风险,反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲,市场风险是开放式基金面临的重大风险,也往往是众多风险中最基本和最常见,也是最难防范的风险,其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	178,465,857.09	-	-	-	178,465,857.09
结算备付金	7,693,630.53	-	-	-	7,693,630.53
存出保证金	-	-	-	1,381,355.05	1,381,355.05
交易性金融资产	-	-	-	2,715,335,617.35	2,715,335,617.35
应收利息	-	-	-	38,391.66	38,391.66
应收申购款	1,388,836.06	-	-	-	1,388,836.06
资产总计	187,548,323.68	-	-	2,716,755,364.06	2,904,303,687.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	27,961,619.88	27,961,619.88
应付赎回款	-	-	-	1,591,348.62	1,591,348.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,582,257	1,582,257.81

				.81	
应付托管费	-	-	-	395,564.46	395,564.46
应付交易费用	-	-	-	473,696.33	473,696.33
其他负债	-	-	-	283,411.14	283,411.14
负债总计	-	-	-	32,287,898.24	32,287,898.24
利率敏感度缺口	187,548,323.68	-	-	2,684,467,465.82	2,872,015,789.50
上年度末2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	191,278,749.35	-	-	-	191,278,749.35
结算备付金	1,744,639.64	-	-	-	1,744,639.64
存出保证金	-	-	-	2,134,043.94	2,134,043.94
交易性金融资产	-	568,139.04	-	3,552,915,245.23	3,553,483,384.27
应收利息	-	-	-	41,810.99	41,810.99
应收申购款	31,761,980.48	-	-	-	31,761,980.48
资产总计	224,785,369.47	568,139.04	-	3,555,091,100.16	3,780,444,608.67
负债					
应付证券清算款	-	-	-	28,677,157.22	28,677,157.22
应付赎回款	-	-	-	3,581,016.25	3,581,016.25
应付管理人报酬	-	-	-	1,961,194.29	1,961,194.29
应付托管费	-	-	-	490,298.57	490,298.57

				7	
应付交易费用	-	-	-	2,109,408.86	2,109,408.86
其他负债	-	-	-	91,578.94	91,578.94
负债总计	-	-	-	36,910,654.13	36,910,654.13
利率敏感度缺口	224,785,369.47	568,139.04	-	3,518,180,446.03	3,743,533,954.54

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率发生变动且其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-5,675.61
	市场利率下降 25 个基点	-	5,750.55

注：本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,715,335,617.35	94.54	3,552,915,245.23	94.91
交易性金融资产-债券投资	-	-	568,139.04	0.02

衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,715,335,617.35	94.54	3,553,483,384.27	94.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化且其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	143,724,854.56	188,472,828.98
	业绩比较基准下降 5%	-143,724,854.56	-188,472,828.98

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,715,335,617.35	93.49
	其中: 股票	2,715,335,617.35	93.49
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	186,159,487.62	6.41
6	其他各项资产	2,808,582.77	0.10
7	合计	2,904,303,687.74	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	46,624,876.49	1.62

B	采掘业	56,142,859.05	1.95
C	制造业	1,559,271,479.54	54.29
C0	食品、饮料	145,479,887.15	5.07
C1	纺织、服装、皮毛	64,221,924.08	2.24
C2	木材、家具	11,451,110.84	0.40
C3	造纸、印刷	60,929,227.65	2.12
C4	石油、化学、塑胶、塑料	264,612,906.54	9.21
C5	电子	216,914,291.59	7.55
C6	金属、非金属	192,804,996.07	6.71
C7	机械、设备、仪表	368,890,006.09	12.84
C8	医药、生物制品	204,545,506.13	7.12
C99	其他制造业	29,421,623.40	1.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	97,687,221.12	3.40
E	建筑业	65,836,058.65	2.29
F	交通运输、仓储业	114,464,904.77	3.99
G	信息技术业	158,505,337.54	5.52
H	批发和零售贸易	191,469,048.96	6.67
I	金融、保险业	22,725,635.80	0.79
J	房地产业	153,846,349.93	5.36
K	社会服务业	100,774,238.64	3.51
L	传播与文化产业	56,328,197.34	1.96
M	综合类	91,659,409.52	3.19
	合计	2,715,335,617.35	94.54

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000581	威孚高科	702,368	25,207,987.52	0.88
2	000917	电广传媒	631,029	16,021,826.31	0.56
3	000970	中科三环	788,191	15,755,938.09	0.55
4	600079	人福医药	766,145	14,763,614.15	0.51
5	002038	双鹭药业	441,671	14,508,892.35	0.51
6	600160	巨化股份	687,572	13,785,818.60	0.48
7	600770	综艺股份	857,559	13,660,914.87	0.48
8	000939	凯迪电力	1,281,574	13,584,684.40	0.47
9	002065	东华软件	613,865	13,541,861.90	0.47
10	600805	悦达投资	1,101,061	13,532,039.69	0.47
11	002236	大华股份	269,635	13,373,896.00	0.47

12	600637	百视通	864,648	13,012,952.40	0.45
13	002123	荣信股份	779,670	12,732,011.10	0.44
14	002353	杰瑞股份	177,575	12,430,250.00	0.43
15	600138	中青旅	806,130	12,140,317.80	0.42
16	000826	桑德环境	481,341	12,129,793.20	0.42
17	600060	海信电器	1,011,806	12,020,255.28	0.42
18	600570	恒生电子	968,538	11,854,905.12	0.41
19	000816	江淮动力	1,640,391	11,548,352.64	0.40
20	600601	方正科技	4,260,148	11,459,798.12	0.40
21	000400	许继电气	587,384	11,365,880.40	0.40
22	600199	金种子酒	755,140	11,251,586.00	0.39
23	000963	华东医药	421,252	11,213,728.24	0.39
24	000759	中百集团	1,321,794	11,169,159.30	0.39
25	000998	隆平高科	430,432	11,109,449.92	0.39
26	002008	大族激光	1,615,659	10,598,723.04	0.37
27	600880	博瑞传播	853,207	10,579,766.80	0.37
28	600750	江中药业	362,336	10,507,744.00	0.37
29	600366	宁波韵升	698,997	10,366,125.51	0.36
30	600311	荣华实业	1,291,828	10,244,196.04	0.36
31	600643	爱建股份	1,592,331	10,190,918.40	0.35
32	600436	片仔癀	135,903	10,075,848.42	0.35
33	000541	佛山照明	1,023,540	9,979,515.00	0.35
34	002344	海宁皮城	433,212	9,803,587.56	0.34
35	002022	科华生物	948,900	9,726,225.00	0.34
36	600522	中天科技	607,693	9,710,934.14	0.34
37	000596	古井贡酒	111,652	9,599,838.96	0.33
38	000877	天山股份	449,659	9,532,770.80	0.33
39	000540	中天城投	1,489,208	9,486,254.96	0.33
40	600298	安琪酵母	319,923	9,408,935.43	0.33
41	600259	广晟有色	242,016	9,228,070.08	0.32
42	600594	益佰制药	547,771	9,191,597.38	0.32
43	600325	华发股份	1,268,684	9,172,585.32	0.32
44	000930	中粮生化	1,497,483	9,044,797.32	0.31
45	000501	鄂武商 A	590,751	9,008,952.75	0.31
46	600210	紫江企业	2,230,824	8,945,604.24	0.31
47	000799	酒鬼酒	376,992	8,863,081.92	0.31
48	600867	通化东宝	1,054,587	8,826,893.19	0.31
49	000650	仁和药业	733,999	8,815,327.99	0.31
50	002051	中工国际	347,867	8,759,291.06	0.30
51	600584	长电科技	1,655,902	8,726,603.54	0.30
52	002250	联化科技	460,633	8,696,751.04	0.30

53	000655	金岭矿业	582,931	8,627,378.80	0.30
54	000762	西藏矿业	431,126	8,613,897.48	0.30
55	600072	中船股份	557,163	8,608,168.35	0.30
56	000417	合肥百货	608,227	8,594,247.51	0.30
57	000503	海虹控股	1,395,591	8,554,972.83	0.30
58	002230	科大讯飞	242,883	8,500,905.00	0.30
59	600141	兴发集团	496,559	8,486,193.31	0.30
60	600557	康缘药业	575,051	8,459,000.21	0.29
61	000830	鲁西化工	1,421,567	8,458,323.65	0.29
62	601588	北辰实业	3,097,736	8,456,819.28	0.29
63	600110	中科英华	2,202,153	8,434,245.99	0.29
64	600653	中华控股	3,389,598	8,372,307.06	0.29
65	600022	济南钢铁	2,422,644	8,358,121.80	0.29
66	000636	风华高科	1,302,319	8,321,818.41	0.29
67	600816	安信信托	616,934	8,297,762.30	0.29
68	600797	浙大网新	1,634,314	8,269,628.84	0.29
69	600844	丹化科技	681,042	8,131,641.48	0.28
70	002233	塔牌集团	862,275	8,105,385.00	0.28
71	000488	晨鸣纸业	1,728,627	8,089,974.36	0.28
72	002154	报喜鸟	681,612	8,070,286.08	0.28
73	002140	东华科技	345,036	7,935,828.00	0.28
74	600651	飞乐音响	1,195,346	7,925,143.98	0.28
75	600747	大连控股	1,652,663	7,899,729.14	0.28
76	600586	金晶科技	1,656,838	7,886,548.88	0.27
77	600787	中储股份	978,316	7,865,660.64	0.27
78	600499	科达机电	858,664	7,865,362.24	0.27
79	000926	福星股份	1,106,073	7,830,996.84	0.27
80	002041	登海种业	272,256	7,791,966.72	0.27
81	600059	古越龙山	739,351	7,763,185.50	0.27
82	600458	时代新材	702,888	7,745,825.76	0.27
83	600820	隧道股份	982,948	7,735,800.76	0.27
84	600858	银座股份	392,593	7,702,674.66	0.27
85	600831	广电网络	765,527	7,647,614.73	0.27
86	600388	龙净环保	332,009	7,646,167.27	0.27
87	600702	沱牌舍得	458,305	7,621,612.15	0.27
88	000667	名流置业	3,477,580	7,581,124.40	0.26
89	000522	白云山 A	618,290	7,518,406.40	0.26
90	600351	亚宝药业	1,228,496	7,506,110.56	0.26
91	600410	华胜天成	738,771	7,491,137.94	0.26
92	002161	远望谷	428,690	7,450,632.20	0.26
93	600783	鲁信创投	433,431	7,446,344.58	0.26

94	000598	兴蓉投资	895,600	7,406,612.00	0.26
95	000616	亿城股份	2,313,337	7,402,678.40	0.26
96	000571	新大洲 A	1,428,643	7,371,797.88	0.26
97	600158	中体产业	1,310,112	7,336,627.20	0.26
98	000962	东方铝业	513,371	7,315,536.75	0.25
99	600851	海欣股份	1,146,232	7,301,497.84	0.25
100	600597	光明乳业	814,594	7,290,616.30	0.25
101	001696	宗申动力	1,189,101	7,229,734.08	0.25
102	000860	顺鑫农业	510,685	7,144,483.15	0.25
103	600409	三友化工	1,028,264	7,136,152.16	0.25
104	600439	瑞贝卡	1,068,079	7,102,725.35	0.25
105	600755	厦门国贸	1,808,167	7,069,932.97	0.25
106	002097	山河智能	817,963	7,042,661.43	0.25
107	000735	罗牛山	1,708,299	7,038,191.88	0.25
108	600704	物产中大	894,975	7,016,604.00	0.24
109	600426	华鲁恒升	925,446	6,987,117.30	0.24
110	600017	日照港	2,552,934	6,892,921.80	0.24
111	600478	科力远	427,776	6,887,193.60	0.24
112	000726	鲁泰 A	879,270	6,875,891.40	0.24
113	600575	芜湖港	812,748	6,875,848.08	0.24
114	000683	远兴能源	1,192,262	6,855,506.50	0.24
115	600596	新安股份	1,054,636	6,855,134.00	0.24
116	600884	杉杉股份	558,174	6,854,376.72	0.24
117	000900	现代投资	542,314	6,822,310.12	0.24
118	600330	天通股份	914,266	6,820,424.36	0.24
119	600069	银鸽投资	1,121,436	6,795,902.16	0.24
120	600765	中航重机	754,974	6,757,017.30	0.24
121	600236	桂冠电力	1,770,430	6,709,929.70	0.23
122	600511	国药股份	557,595	6,685,564.05	0.23
123	600993	马应龙	386,172	6,676,913.88	0.23
124	000988	华工科技	518,886	6,672,873.96	0.23
125	600720	祁连山	727,362	6,611,720.58	0.23
126	600425	青松建化	557,434	6,605,592.90	0.23
127	000973	佛塑科技	951,087	6,581,522.04	0.23
128	600195	中牧股份	378,437	6,562,097.58	0.23
129	600251	冠农股份	351,438	6,561,347.46	0.23
130	600467	好当家	708,967	6,550,855.08	0.23
131	600240	华业地产	876,374	6,537,750.04	0.23
132	002056	横店东磁	411,800	6,527,030.00	0.23
133	000078	海王生物	1,013,217	6,525,117.48	0.23
134	000887	中鼎股份	578,143	6,521,453.04	0.23

135	600496	精工钢构	796,981	6,471,485.72	0.23
136	600872	中炬高新	1,546,211	6,447,699.87	0.22
137	000997	新大陆	594,184	6,429,070.88	0.22
138	600087	长航油运	3,293,914	6,423,132.30	0.22
139	000066	长城电脑	1,284,451	6,383,721.47	0.22
140	600033	福建高速	2,663,300	6,338,654.00	0.22
141	600064	南京高科	701,349	6,333,181.47	0.22
142	002277	友阿股份	408,508	6,331,874.00	0.22
143	002078	太阳纸业	774,769	6,283,376.59	0.22
144	600261	阳光照明	363,574	6,264,380.02	0.22
145	600611	大众交通	1,213,718	6,250,647.70	0.22
146	600723	首商股份	638,920	6,235,859.20	0.22
147	600835	上海机电	782,667	6,206,549.31	0.22
148	600326	西藏天路	743,473	6,178,260.63	0.22
149	600529	山东药玻	499,590	6,159,944.70	0.21
150	600685	广船国际	425,552	6,153,481.92	0.21
151	600815	厦工股份	756,639	6,143,908.68	0.21
152	600491	龙元建设	1,103,516	6,135,548.96	0.21
153	000717	韶钢松山	2,268,244	6,124,258.80	0.21
154	600289	亿阳信通	896,810	6,116,244.20	0.21
155	600654	飞乐股份	1,465,455	6,110,947.35	0.21
156	000786	北新建材	558,172	6,095,238.24	0.21
157	000751	锌业股份	1,508,297	6,093,519.88	0.21
158	600067	冠城大通	999,281	6,085,621.29	0.21
159	600963	岳阳林纸	1,291,345	6,043,494.60	0.21
160	002254	泰和新材	530,000	6,042,000.00	0.21
161	600628	新世界	825,708	6,027,668.40	0.21
162	000659	珠海中富	1,746,846	6,026,618.70	0.21
163	002311	海大集团	337,837	6,013,498.60	0.21
164	600754	锦江股份	347,205	6,010,118.55	0.21
165	000848	承德露露	425,022	6,005,560.86	0.21
166	000594	国恒铁路	2,899,292	6,001,534.44	0.21
167	000682	东方电子	1,898,512	5,999,297.92	0.21
168	600509	天富热电	763,588	5,994,165.80	0.21
169	000627	天茂集团	2,101,802	5,990,135.70	0.21
170	000850	华茂股份	1,098,944	5,989,244.80	0.21
171	600525	长园集团	837,987	5,983,227.18	0.21
172	002292	奥飞动漫	236,802	5,950,834.26	0.21
173	000510	金路集团	1,182,326	5,947,099.78	0.21
174	000897	津滨发展	2,511,162	5,926,342.32	0.21
175	600761	安徽合力	581,976	5,924,515.68	0.21

176	600021	上海电力	1,245,956	5,893,371.88	0.21
177	000601	韶能股份	1,796,456	5,874,411.12	0.20
178	600991	广汽长丰	398,856	5,871,160.32	0.20
179	600176	中国玻纤	451,669	5,862,663.62	0.20
180	600332	广州药业	445,169	5,849,520.66	0.20
181	000088	盐田港	1,159,942	5,834,508.26	0.20
182	002129	中环股份	560,216	5,826,246.40	0.20
183	600121	郑州煤电	556,101	5,800,133.43	0.20
184	000028	一致药业	271,664	5,800,026.40	0.20
185	600978	宜华木业	1,566,075	5,794,477.50	0.20
186	600227	赤天化	1,475,679	5,755,148.10	0.20
187	600521	华海药业	522,737	5,750,107.00	0.20
188	002011	盾安环境	641,707	5,704,775.23	0.20
189	600038	哈飞股份	327,367	5,702,733.14	0.20
190	600888	新疆众和	398,873	5,695,906.44	0.20
191	600416	湘电股份	826,759	5,688,101.92	0.20
192	600545	新疆城建	1,049,318	5,634,837.66	0.20
193	600308	华泰股份	1,586,335	5,631,489.25	0.20
194	600295	鄂尔多斯	475,169	5,626,000.96	0.20
195	600117	西宁特钢	863,153	5,619,126.03	0.20
196	600780	通宝能源	890,061	5,589,583.08	0.19
197	002083	孚日股份	1,088,920	5,586,159.60	0.19
198	600616	金枫酒业	595,980	5,584,332.60	0.19
199	002249	大洋电机	369,204	5,519,599.80	0.19
200	600122	宏图高科	1,319,239	5,514,419.02	0.19
201	600322	天房发展	1,716,854	5,511,101.34	0.19
202	000006	深振业 A	1,343,676	5,509,071.60	0.19
203	000987	广州友谊	348,374	5,497,341.72	0.19
204	600435	中兵光电	722,638	5,492,048.80	0.19
205	600449	宁夏建材	278,499	5,475,290.34	0.19
206	600387	海越股份	599,517	5,473,590.21	0.19
207	000525	红太阳	393,842	5,462,588.54	0.19
208	600408	安泰集团	1,367,845	5,457,701.55	0.19
209	600790	轻纺城	960,760	5,457,116.80	0.19
210	000089	深圳机场	1,312,272	5,445,928.80	0.19
211	600581	八一钢铁	743,787	5,437,082.97	0.19
212	600163	福建南纸	966,798	5,433,404.76	0.19
213	600531	豫光金铅	343,795	5,411,333.30	0.19
214	600736	苏州高新	1,231,969	5,408,343.91	0.19
215	002431	棕榈园林	222,025	5,368,564.50	0.19
216	002237	恒邦股份	175,480	5,353,894.80	0.19

217	600078	澄星股份	771,206	5,344,457.58	0.19
218	600086	东方金钰	410,203	5,328,536.97	0.19
219	600662	强生控股	1,226,704	5,323,895.36	0.19
220	000159	国际实业	653,692	5,307,979.04	0.18
221	600337	美克股份	614,017	5,298,966.71	0.18
222	000861	海印股份	382,154	5,285,189.82	0.18
223	600112	长征电气	494,158	5,277,607.44	0.18
224	002475	立讯精密	150,679	5,258,697.10	0.18
225	002430	杭氧股份	231,908	5,197,058.28	0.18
226	600103	青山纸业	1,648,721	5,176,983.94	0.18
227	002410	广联达	156,566	5,171,374.98	0.18
228	002181	粤传媒	472,403	5,163,364.79	0.18
229	002308	威创股份	496,088	5,144,432.56	0.18
230	000554	泰山石油	746,535	5,143,626.15	0.18
231	600995	文山电力	743,023	5,082,277.32	0.18
232	002179	中航光电	309,651	5,078,276.40	0.18
233	600773	西藏城投	446,959	5,072,984.65	0.18
234	600339	天利高新	785,511	5,058,690.84	0.18
235	600127	金健米业	1,056,791	5,051,460.98	0.18
236	000005	世纪星源	1,299,171	5,014,800.06	0.17
237	600198	大唐电信	596,410	5,009,844.00	0.17
238	002281	光迅科技	154,662	5,001,769.08	0.17
239	600824	益民集团	994,515	4,992,465.30	0.17
240	600468	百利电气	354,202	4,987,164.16	0.17
241	000698	沈阳化工	897,958	4,983,666.90	0.17
242	600482	风帆股份	626,368	4,967,098.24	0.17
243	600874	创业环保	844,091	4,963,255.08	0.17
244	600569	安阳钢铁	1,858,341	4,961,770.47	0.17
245	600292	九龙电力	397,438	4,956,051.86	0.17
246	002223	鱼跃医疗	236,459	4,953,816.05	0.17
247	002408	齐翔腾达	271,032	4,940,913.36	0.17
248	002025	航天电器	382,901	4,931,764.88	0.17
249	600106	重庆路桥	704,719	4,904,844.24	0.17
250	600589	广东榕泰	817,559	4,897,178.41	0.17
251	600006	东风汽车	1,552,720	4,875,540.80	0.17
252	600284	浦东建设	644,647	4,873,531.32	0.17
253	000407	胜利股份	1,260,110	4,813,620.20	0.17
254	600056	中国医药	236,263	4,781,963.12	0.17
255	000886	海南高速	1,535,364	4,774,982.04	0.17
256	600866	星湖科技	854,590	4,768,612.20	0.17
257	600759	正和股份	710,424	4,752,736.56	0.17

258	600171	上海贝岭	1,046,222	4,749,847.88	0.17
259	600263	路桥建设	316,886	4,746,952.28	0.17
260	000713	丰乐种业	348,084	4,737,423.24	0.16
261	600673	东阳光铝	642,419	4,721,779.65	0.16
262	600580	卧龙电气	934,397	4,718,704.85	0.16
263	000301	东方市场	1,655,119	4,717,089.15	0.16
264	000823	超声电子	593,964	4,716,074.16	0.16
265	600961	株冶集团	511,852	4,714,156.92	0.16
266	002191	劲嘉股份	496,578	4,707,559.44	0.16
267	002332	仙琚制药	396,039	4,665,339.42	0.16
268	600825	新华传媒	811,213	4,656,362.62	0.16
269	000996	中国中期	357,176	4,650,431.52	0.16
270	000777	中核科技	248,042	4,630,944.14	0.16
271	002048	宁波华翔	642,491	4,625,935.20	0.16
272	600622	嘉宝集团	798,529	4,623,482.91	0.16
273	600693	东百集团	666,182	4,596,655.80	0.16
274	600602	广电电子	1,024,278	4,568,279.88	0.16
275	000931	中关村	916,841	4,529,194.54	0.16
276	600088	中视传媒	321,672	4,503,408.00	0.16
277	600801	华新水泥	353,618	4,501,557.14	0.16
278	600543	莫高股份	498,611	4,492,485.11	0.16
279	002309	中利科技	232,286	4,487,765.52	0.16
280	600877	中国嘉陵	1,067,157	4,482,059.40	0.16
281	000755	山西三维	637,574	4,469,393.74	0.16
282	600075	新疆天业	510,719	4,458,576.87	0.16
283	000677	ST 海龙	924,948	4,458,249.36	0.16
284	002465	海格通信	192,263	4,452,811.08	0.16
285	000511	银基发展	1,793,172	4,447,066.56	0.15
286	002091	江苏国泰	348,061	4,413,413.48	0.15
287	600327	大东方	607,527	4,386,344.94	0.15
288	000513	丽珠集团	213,919	4,376,782.74	0.15
289	000410	沈阳机床	635,251	4,370,526.88	0.15
290	002482	广田股份	185,035	4,361,274.95	0.15
291	600479	千金药业	411,317	4,339,394.35	0.15
292	000099	中信海直	598,091	4,336,159.75	0.15
293	601678	滨化股份	384,285	4,323,206.25	0.15
294	600361	华联综超	775,368	4,311,046.08	0.15
295	600748	上实发展	841,132	4,306,595.84	0.15
296	600231	凌钢股份	780,300	4,283,847.00	0.15
297	000426	兴业矿业	443,279	4,273,209.56	0.15
298	000537	广宇发展	796,068	4,258,963.80	0.15

299	600360	华微电子	1,052,890	4,253,675.60	0.15
300	600323	南海发展	505,083	4,252,798.86	0.15
301	600555	九龙山	1,133,724	4,251,465.00	0.15
302	000936	华西村	871,130	4,251,114.40	0.15
303	000090	深天健	620,413	4,249,829.05	0.15
304	600846	同济科技	970,077	4,239,236.49	0.15
305	000708	大冶特钢	436,128	4,239,164.16	0.15
306	000563	陕国投 A	417,434	4,236,955.10	0.15
307	600686	金龙汽车	601,361	4,203,513.39	0.15
308	600120	浙江东方	588,614	4,196,817.82	0.15
309	000712	锦龙股份	413,915	4,188,819.80	0.15
310	600282	南钢股份	1,504,488	4,182,476.64	0.15
311	000975	科学城	846,331	4,180,875.14	0.15
312	600590	泰豪科技	618,630	4,157,193.60	0.14
313	600270	外运发展	703,033	4,140,864.37	0.14
314	600226	升华拜克	550,958	4,137,694.58	0.14
315	600838	上海九百	778,058	4,115,926.82	0.14
316	002506	超日太阳	304,838	4,090,925.96	0.14
317	002064	华峰氨纶	856,703	4,069,339.25	0.14
318	600317	营口港	1,065,143	4,068,846.26	0.14
319	000837	秦川发展	541,417	4,022,728.31	0.14
320	600533	栖霞建设	1,222,768	4,010,679.04	0.14
321	600830	香溢融通	617,288	3,975,334.72	0.14
322	002479	富春环保	247,542	3,953,245.74	0.14
323	600776	东方通信	742,183	3,940,991.73	0.14
324	000016	深康佳 A	1,239,526	3,916,902.16	0.14
325	600329	中新药业	418,720	3,915,032.00	0.14
326	000919	金陵药业	489,105	3,907,948.95	0.14
327	600487	亨通光电	241,135	3,906,387.00	0.14
328	600139	西部资源	285,490	3,891,228.70	0.14
329	600789	鲁抗医药	790,158	3,879,675.78	0.14
330	600826	兰生股份	408,218	3,878,071.00	0.14
331	600197	伊力特	425,048	3,876,437.76	0.13
332	000911	南宁糖业	333,849	3,875,986.89	0.13
333	600475	华光股份	298,151	3,872,981.49	0.13
334	600782	新钢股份	811,339	3,861,973.64	0.13
335	000875	吉电股份	1,302,881	3,856,527.76	0.13
336	600507	方大特钢	995,904	3,854,148.48	0.13
337	600102	莱钢股份	537,014	3,850,390.38	0.13
338	601801	皖新传媒	353,208	3,849,967.20	0.13
339	000738	中航动控	366,040	3,847,080.40	0.13

340	600864	哈投股份	636,268	3,843,058.72	0.13
341	600710	常林股份	612,838	3,836,365.88	0.13
342	000533	万家乐	804,464	3,821,204.00	0.13
343	601126	四方股份	236,799	3,784,048.02	0.13
344	600246	万通地产	1,180,845	3,778,704.00	0.13
345	002252	上海莱士	157,782	3,777,301.08	0.13
346	600107	美尔雅	558,968	3,750,675.28	0.13
347	000767	漳泽电力	1,027,736	3,740,959.04	0.13
348	600290	华仪电气	511,307	3,737,654.17	0.13
349	000903	云内动力	924,894	3,736,571.76	0.13
350	601777	力帆股份	553,985	3,733,858.90	0.13
351	600398	凯诺科技	1,004,023	3,724,925.33	0.13
352	600618	氯碱化工	436,578	3,724,010.34	0.13
353	600644	乐山电力	443,528	3,685,717.68	0.13
354	600676	交运股份	851,767	3,679,633.44	0.13
355	600063	皖维高新	908,506	3,670,364.24	0.13
356	600707	彩虹股份	572,031	3,666,718.71	0.13
357	600268	国电南自	493,154	3,644,408.06	0.13
358	600054	黄山旅游	244,855	3,636,096.75	0.13
359	600223	鲁商置业	777,105	3,629,080.35	0.13
360	002345	潮宏基	139,224	3,605,901.60	0.13
361	600429	三元股份	687,132	3,600,571.68	0.13
362	600896	中海海盛	902,670	3,592,626.60	0.13
363	002440	闰土股份	221,773	3,590,504.87	0.13
364	600501	航天晨光	453,329	3,590,365.68	0.13
365	002052	同洲电子	460,571	3,574,030.96	0.12
366	600966	博汇纸业	676,227	3,563,716.29	0.12
367	600641	万业企业	782,337	3,551,809.98	0.12
368	002414	高德红外	174,036	3,548,594.04	0.12
369	002168	深圳惠程	364,840	3,524,354.40	0.12
370	002336	人人乐	231,981	3,521,471.58	0.12
371	600288	大恒科技	593,485	3,501,561.50	0.12
372	600667	太极实业	636,908	3,496,624.92	0.12
373	600563	法拉电子	218,384	3,496,327.84	0.12
374	600363	联创光电	575,805	3,495,136.35	0.12
375	000989	九芝堂	346,623	3,493,959.84	0.12
376	600052	浙江广厦	1,015,277	3,472,247.34	0.12
377	000050	深天马 A	557,267	3,466,200.74	0.12
378	600810	神马股份	429,238	3,459,658.28	0.12
379	000428	华天酒店	837,223	3,457,730.99	0.12
380	600639	浦东金桥	509,828	3,451,535.56	0.12

381	600423	柳化股份	542,571	3,450,751.56	0.12
382	600829	三精制药	337,626	3,447,161.46	0.12
383	600488	天药股份	632,245	3,445,735.25	0.12
384	600894	广钢股份	591,861	3,444,631.02	0.12
385	002242	九阳股份	441,408	3,438,568.32	0.12
386	600480	凌云股份	421,190	3,436,910.40	0.12
387	000520	长航凤凰	1,047,715	3,426,028.05	0.12
388	002121	科陆电子	382,281	3,409,946.52	0.12
389	600328	兰太实业	418,236	3,387,711.60	0.12
390	600082	海泰发展	1,003,203	3,380,794.11	0.12
391	600291	西水股份	521,680	3,375,269.60	0.12
392	600683	京投银泰	718,932	3,371,791.08	0.12
393	000912	泸天化	567,763	3,366,834.59	0.12
394	600293	三峡新材	468,009	3,355,624.53	0.12
395	000608	阳光股份	873,295	3,344,719.85	0.12
396	000158	常山股份	837,128	3,340,140.72	0.12
397	600438	通威股份	667,198	3,329,318.02	0.12
398	600657	信达地产	887,562	3,310,606.26	0.12
399	600420	现代制药	335,121	3,294,239.43	0.11
400	002393	力生制药	105,813	3,288,668.04	0.11
401	002340	格林美	168,138	3,278,691.00	0.11
402	600469	风神股份	430,700	3,277,627.00	0.11
403	600073	上海梅林	387,083	3,274,722.18	0.11
404	000687	保定天鹅	747,189	3,265,215.93	0.11
405	002109	兴化股份	415,834	3,260,138.56	0.11
406	600836	界龙实业	486,900	3,252,492.00	0.11
407	600510	黑牡丹	617,646	3,230,288.58	0.11
408	600202	哈空调	520,793	3,208,084.88	0.11
409	002238	天威视讯	185,245	3,191,771.35	0.11
410	600650	锦江投资	379,060	3,191,685.20	0.11
411	002232	启明信息	394,477	3,171,595.08	0.11
412	002267	陕天然气	196,646	3,122,738.48	0.11
413	600565	迪马股份	978,205	3,120,473.95	0.11
414	000949	新乡化纤	965,684	3,109,502.48	0.11
415	002342	巨力索具	556,870	3,107,334.60	0.11
416	000572	海马汽车	957,590	3,073,863.90	0.11
417	600129	太极集团	497,171	3,072,516.78	0.11
418	002088	鲁阳股份	316,645	3,055,624.25	0.11
419	000733	振华科技	486,538	3,055,458.64	0.11
420	600333	长春燃气	447,916	3,045,828.80	0.11
421	600725	云维股份	598,019	3,037,936.52	0.11

422	000910	大亚科技	614,281	3,034,548.14	0.11
423	000543	皖能电力	600,168	3,030,848.40	0.11
424	000972	新中基	654,980	2,999,808.40	0.10
425	600277	亿利能源	350,154	2,993,816.70	0.10
426	600460	士兰微	337,056	2,986,316.16	0.10
427	002218	拓日新能	284,055	2,985,418.05	0.10
428	600708	海博股份	693,372	2,981,499.60	0.10
429	002183	怡亚通	645,174	2,980,703.88	0.10
430	000852	江钻股份	310,831	2,968,436.05	0.10
431	600168	武汉控股	428,114	2,936,862.04	0.10
432	002306	湘鄂情	194,125	2,911,875.00	0.10
433	002315	焦点科技	68,131	2,888,754.40	0.10
434	002320	海峡股份	190,074	2,883,422.58	0.10
435	600983	合肥三洋	413,656	2,883,182.32	0.10
436	002428	云南锗业	94,658	2,876,656.62	0.10
437	000584	友利控股	555,532	2,872,100.44	0.10
438	600386	北巴传媒	391,271	2,871,929.14	0.10
439	600897	厦门空港	231,209	2,862,367.42	0.10
440	002285	世联地产	252,472	2,857,983.04	0.10
441	002276	万马电缆	333,826	2,854,212.30	0.10
442	600012	皖通高速	678,728	2,843,870.32	0.10
443	600061	中纺投资	499,666	2,838,102.88	0.10
444	600640	中卫国脉	389,468	2,804,169.60	0.10
445	600178	东安动力	448,393	2,757,616.95	0.10
446	600523	贵航股份	280,237	2,737,915.49	0.10
447	002437	誉衡药业	161,891	2,735,957.90	0.10
448	600191	华资实业	470,648	2,729,758.40	0.10
449	002444	巨星科技	293,184	2,726,611.20	0.09
450	601000	唐山港	437,887	2,706,141.66	0.09
451	000905	厦门港务	515,337	2,705,519.25	0.09
452	600806	昆明机床	454,426	2,699,290.44	0.09
453	002326	永太科技	185,821	2,692,546.29	0.09
454	002225	濮耐股份	282,464	2,643,863.04	0.09
455	002489	浙江永强	139,770	2,622,085.20	0.09
456	600126	杭钢股份	651,365	2,592,432.70	0.09
457	002287	奇正藏药	157,559	2,583,967.60	0.09
458	600287	江苏舜天	423,922	2,581,684.98	0.09
459	002194	武汉凡谷	321,412	2,561,653.64	0.09
460	000899	赣能股份	627,578	2,560,518.24	0.09
461	000042	深长城	185,931	2,556,551.25	0.09
462	000990	诚志股份	345,900	2,545,824.00	0.09

463	000514	渝开发	541,347	2,506,436.61	0.09
464	601999	出版传媒	320,738	2,498,549.02	0.09
465	600743	华远地产	736,221	2,481,064.77	0.09
466	002386	天原集团	278,354	2,474,567.06	0.09
467	600035	楚天高速	723,302	2,423,061.70	0.08
468	000597	东北制药	323,996	2,374,890.68	0.08
469	002328	新朋股份	232,022	2,368,944.62	0.08
470	000925	众合机电	233,992	2,358,639.36	0.08
471	000631	顺发恒业	608,739	2,325,382.98	0.08
472	000619	海螺型材	419,237	2,322,572.98	0.08
473	600258	首旅股份	179,635	2,256,215.60	0.08
474	600359	新农开发	311,550	2,252,506.50	0.08
475	600834	申通地铁	370,597	2,249,523.79	0.08
476	002383	合众思壮	83,530	2,246,957.00	0.08
477	002314	雅致股份	224,303	2,238,543.94	0.08
478	000893	东凌粮油	172,323	2,228,136.39	0.08
479	002110	三钢闽光	310,157	2,205,216.27	0.08
480	002062	宏润建设	346,949	2,144,144.82	0.07
481	000979	中弘股份	392,870	2,141,141.50	0.07
482	002384	东山精密	111,364	2,135,961.52	0.07
483	002463	沪电股份	322,410	2,127,906.00	0.07
484	000517	荣安地产	411,969	2,105,161.59	0.07
485	002429	兆驰股份	273,250	2,090,362.50	0.07
486	000617	石油济柴	223,215	2,084,828.10	0.07
487	002480	新筑股份	161,942	2,008,080.80	0.07
488	002449	国星光电	124,263	1,994,421.15	0.07
489	000950	建峰化工	464,903	1,971,188.72	0.07
490	002362	汉王科技	165,592	1,920,867.20	0.07
491	002172	澳洋科技	536,130	1,892,538.90	0.07
492	600230	沧州大化	248,207	1,846,660.08	0.06
493	000883	湖北能源	371,838	1,784,822.40	0.06
494	000029	深深房 A	519,192	1,692,565.92	0.06
495	600278	东方创业	233,878	1,660,533.80	0.06
496	600648	外高桥	147,127	1,369,752.37	0.05
497	600623	双钱股份	121,000	1,199,110.00	0.04
498	002534	杭锅股份	64,022	1,161,359.08	0.04
499	601002	晋亿实业	28,631	279,724.87	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600750	江中药业	28,322,776.66	0.76
2	600311	荣华实业	25,829,544.89	0.69
3	600376	首开股份	25,686,651.20	0.69
4	000789	江西水泥	23,747,310.56	0.63
5	600160	巨化股份	21,974,659.14	0.59
6	002081	金螳螂	20,241,387.00	0.54
7	600643	爱建股份	19,460,946.67	0.52
8	601000	唐山港	18,424,684.07	0.49
9	600259	广晟有色	17,770,532.67	0.47
10	000751	锌业股份	17,455,064.85	0.47
11	000655	金岭矿业	16,976,178.28	0.45
12	000488	晨鸣纸业	16,541,806.51	0.44
13	000897	津滨发展	16,476,684.10	0.44
14	600601	方正科技	15,935,275.52	0.43
15	000401	冀东水泥	15,678,518.37	0.42
16	600816	安信信托	15,513,618.84	0.41
17	002353	杰瑞股份	15,231,319.04	0.41
18	600176	中国玻纤	15,149,372.34	0.40
19	600325	华发股份	14,447,005.67	0.39
20	600435	中兵光电	14,443,936.06	0.39

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600252	中恒集团	38,397,761.05	1.03
2	600750	江中药业	37,179,126.83	0.99
3	002073	软控股份	35,780,431.24	0.96
4	600160	巨化股份	26,422,898.97	0.71
5	002106	莱宝高科	25,264,443.29	0.67
6	600376	首开股份	23,106,150.56	0.62
7	000789	江西水泥	20,897,547.29	0.56

8	002293	罗莱家纺	20,329,015.95	0.54
9	601002	晋亿实业	19,405,122.61	0.52
10	600971	恒源煤电	17,755,379.75	0.47
11	002081	金螳螂	17,022,495.01	0.45
12	600267	海正药业	16,910,133.20	0.45
13	002152	广电运通	16,331,149.78	0.44
14	000559	万向钱潮	15,824,656.49	0.42
15	002092	中泰化学	15,344,060.62	0.41
16	600315	上海家化	15,285,796.38	0.41
17	600439	瑞贝卡	13,620,677.93	0.36
18	002241	歌尔声学	13,311,433.06	0.36
19	601000	唐山港	12,946,692.69	0.35
20	000401	冀东水泥	12,690,938.65	0.34

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,715,652,693.23
卖出股票的收入（成交）总额	2,218,362,314.35

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，

也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,381,355.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,391.66
5	应收申购款	1,388,836.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,808,582.77

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
188,527	20,611.57	359,594,556.48	9.25%	3,526,242,155.69	90.75%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	王玩嫦	5,000,450.00	2.96%
2	汕头市晶莹物业管理有限公司	3,047,291.00	1.80%
3	姚惠民	2,509,800.00	1.48%
4	李建军	2,500,300.00	1.48%

5	张正邦	2,010,480.00	1.19%
6	上海同济协力建设工程咨询有限公司	2,000,000.00	1.18%
7	高琪	1,482,817.00	0.88%
8	霍宝仪	1,474,718.00	0.87%
9	吴彤	1,390,200.00	0.82%
10	莫锐玲	1,381,100.00	0.82%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	7,473,070.19	0.1923%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年11月26日)基金份额总额	8,635,797,223.98
本报告期期初基金份额总额	3,418,670,771.06
本报告期基金总申购份额	2,911,914,193.26
减：本报告期基金总赎回份额	2,444,748,252.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,885,836,712.17

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人人事变动如下：

(一) 董事长、法定代表人变更

因我司第三届董事会任期届满，原董事长马庆泉因年龄原因不再任职。2011年3月16日，经我司第四届董事会第一次会议审议通过，选举王志伟为广发基金管理有限公司董事长。在中国证监会核准

王志伟的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后, 该任职事项方正式生效。董事会授权公司副董事长、总经理林传辉在中国证监会核准拟任董事长的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项前, 代为履行董事长职责。代为履行职责的时间不得超过 90 日, 法律、行政法规另有规定的除外。

2011 年 6 月 15 日, 公司在指定信息披露媒体刊登了《基金行业高级管理人员变更公告》, 披露因我司拟任董事长王志伟先生的高级管理人员任职资格尚处于报批阶段, 在其高管任职资格获准前, 继续由公司副董事长、总经理林传辉先生代为履行董事长职责。2011 年 7 月 19 日, 公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司王志伟基金行业高级管理人员任职资格的批复》(证监许可[2011]1119 号)。中国证监会核准了王志伟的基金行业高级管理人员任职资格, 并对王志伟任我司董事长无异议。自 2011 年 7 月 19 日起, 王志伟正式履行董事长职务。

2011 年 8 月 5 日, 我司完成公司法定代表人变更的工商登记工作, 公司法定代表人正式变更为现任董事长王志伟。

(二) 聘任副总经理

2011 年 3 月 16 日, 经我司第四届董事会第一次会议审议通过, 董事会新聘任易阳方担任我司副总经理。在中国证监会核准易阳方的基金管理公司高级管理人员任职资格和任职事项后, 该任职事项方正式生效。

2011 年 8 月 11 日, 公司收到中国证监会《关于核准广发基金管理有限公司易阳方基金行业高级管理人员任职资格的批复》(证监许可[2011]1267 号), 中国证监会核准了易阳方的基金行业高级管理人员任职资格, 并对易阳方任公司副总经理无异议。

自 2011 年 8 月 11 日起, 易阳方副总经理任职正式生效。

本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期，本基金应支付德勤华永会计师事务所有限公司审计费 80,000.00 元。截至本报告期末，该事务所已为本基金提供审计服务 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	4	90,876,488.32	1.85%	77,245.36	1.99%	新增 3 个
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
长城证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
长江证券	2	110,391,853.39	2.25%	89,694.63	2.32%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	7,508,340.36	0.15%	6,382.26	0.16%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
东兴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
方正证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
光大证券	3	26,474,255.90	0.54%	22,503.35	0.58%	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	6	494,904,892.34	10.07%	420,670.58	10.86%	-
广州证券	1	70,483,170.42	1.43%	43,171.09	1.11%	新增 1 个
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	55,560,902.06	1.13%	45,143.82	1.17%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	261,680,921.31	5.32%	212,617.73	5.49%	-
国信证券	4	734,453,188.41	14.94%	596,749.87	15.41%	新增 3 个
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	389,734,984.76	7.93%	331,274.84	8.56%	-
红塔证券	1	77,689,904.40	1.58%	47,585.54	1.23%	新增 1 个
宏源证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	48,365,206.14	0.98%	41,110.62	1.06%	-
华创证券	1	29,769,523.11	0.61%	25,304.11	0.65%	-
华融证券	1	128,280,321.46	2.61%	78,572.29	2.03%	-
华泰联合	4	10,229,241.89	0.21%	8,311.46	0.21%	新增 3 个
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	562,378,004.90	11.44%	365,543.97	9.44%	新增 1 个
民生证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
南京证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
平安证券	4	-	-	-	-	新增 1 个

齐鲁证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
瑞银证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
山西证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
申银万国	2	457,978,728.97	9.32%	389,279.73	10.05%	新增 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	48,679,671.17	0.99%	41,377.94	1.07%	新增 1 个
信达证券	1	202,657,852.00	4.12%	131,727.54	3.40%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	3	162,536,180.07	3.31%	132,419.50	3.42%	新增 1 个
英大证券	1	72,884,668.86	1.48%	47,374.48	1.22%	-
招商证券	3	104,307,100.95	2.12%	88,661.16	2.29%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	4	17,407,626.98	0.35%	14,796.45	0.38%	新增 1 个
中信证券	3	749,268,686.91	15.25%	614,430.39	15.87%	新增 2 个
中银国际	1	-	-	-	-	新增 1 个
中原证券	2	-	-	-	-	新增 1 个

注：(1) 交易席位选择标准：

- (一) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (二) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (三) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (四) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(五) 能积极为公司投资业务的开展, 提供良好的信息交流和客户服务;

(六) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

(2) 交易席位选择流程:

1、对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估, 确定选用交易单元的券商。

2、协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议, 并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,298,638.37	45.77%	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	375,000,000.00	4.47%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	200,000,000.00	2.38%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	764,451.00	26.94%	488,000,000.00	5.82%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	774,410.79	27.29%	-	-	-	-

国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,030,000,000.00	12.28%	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	200,000,000.00	2.38%	-	-
华创证券	-	-	715,000,000.00	8.52%	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	1,550,000,000.00	18.48%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	340,000,000.00	4.05%	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
厦门证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	430,000,000.00	5.13%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	240,000,000.00	2.86%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	90,000,000.00	1.07%	-	-
中信证券	-	-	2,730,000,000.00	32.55%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于增加财达证券	《中国证券报》、《证	2011-01-24

	为基金代销机构的公告	券时报》、《上海证券报》	
2	广发基金管理有限公司关于增加财达证券为基金代销机构的补充公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-01-26
3	广发基金管理有限公司关于调整旗下基金通过中信建投证券定期定额投资申购起点金额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
4	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
5	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销(含定期定额投资)申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-03-01
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加东莞银行网上银行及定期定额方式申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
7	广发基金管理有限公司关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-01
8	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-06
9	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-11
10	广发基金管理有限公司关于增加国金证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-12
11	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加华夏银行基金定投申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-12
12	广发基金管理有限公司关于增加中天证券为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
13	广发基金管理有限公司关于增加浙江稠州商业银行为基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-15
14	广发基金管理有限公司关于增加中天证券为基金代销机构的补充公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-04-18
15	广发基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券推出定期定额投资等业务公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证	2011-05-11

		券报》	
16	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行等电子渠道申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-06-30
17	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券非现场交易申购基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-01
18	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加浙商证券非现场委托基金申购的费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-01
19	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券非现场交易基金申购费率优惠活动的补充公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-04
20	广发基金管理有限公司关于增加上海银行为广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-13
21	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加厦门证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-07-22
22	广发基金管理有限公司关于旗下基金参加长江证券网上交易及手机证券交易基金申购 (含定投) 费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-08
23	广发基金管理有限公司关于增加南京银行为旗下基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-18
24	广发基金管理有限公司关于增加新时代证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-26
25	广发基金管理有限公司关于开展中国工商银行借记卡网上直销 (含定期定额投资) 申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-31
26	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-08-31
27	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广州银行为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-10-20
28	广发基金管理有限公司关于增加世纪证券为广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-11-03
29	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华安证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-11-07

30	广发基金管理有限公司关于网上直销业务增加通联支付第三方支付业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-11-14
31	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民族证券基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-12-05
32	广发基金管理有限公司关于旗下基金增加日信证券为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2011-12-06

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 募集的文件;
- 2.《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》;
- 3.《广发中证 500 指数证券投资基金托管协议》;
- 4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
- 5.《广发中证 500 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》及更新版;
- 6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1.书面查阅: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅, 也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅: 基金管理人网址: <http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问, 可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司, 咨询电话 95105828 或 020-83936999, 或发电子邮件: services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日